

Table 10: Supplementary performance measures obtained through simulations of $N = 1,000$ bivariate data generated through the mean slippage model with correlation $[\rho = 0.9]$

ρ	n	ϵ	k	p_2			p_4			p_5		
				ATLA	FSM	FS	ATLA	FSM	FS	ATLA	FSM	FS
0.9	25	0.04	1	0.457	0.494	0.641	0.457	0.494	0.641	0.458	0.495	0.643
		0.08	2	0.581	0.518	0.555	0.547	0.317	0.464	0.581	0.519	0.556
		0.16	4	0.617	0.361	0.348	0.565	0.162	0.312	0.618	0.361	0.350
		0.24	6	0.568	0.398	0.249	0.509	0.109	0.233	0.570	0.398	0.251
		0.32	8	0.527	0.392	0.212	0.489	0.080	0.198	0.528	0.393	0.214
		0.40	10	0.413	0.005	0.188	0.383	0.000	0.180	0.414	0.006	0.190
	50	0.02	1	0.604	0.667	0.751	0.604	0.667	0.751	0.604	0.668	0.752
		0.04	2	0.805	0.794	0.810	0.697	0.489	0.577	0.805	0.794	0.810
		0.08	4	0.867	0.738	0.612	0.667	0.299	0.392	0.867	0.738	0.612
		0.16	8	0.853	0.811	0.240	0.660	0.153	0.188	0.853	0.811	0.242
		0.24	12	0.844	0.819	0.128	0.668	0.072	0.106	0.845	0.819	0.128
		0.32	16	0.819	0.762	0.100	0.671	0.064	0.092	0.820	0.762	0.100
		0.40	20	0.716	0.166	0.080	0.599	0.000	0.077	0.717	0.168	0.083
	100	0.02	2	0.776	0.865	0.875	0.624	0.532	0.583	0.776	0.865	0.875
		0.04	4	0.911	0.950	0.872	0.586	0.320	0.345	0.911	0.950	0.872
		0.08	8	0.931	0.993	0.464	0.575	0.147	0.162	0.931	0.993	0.464
		0.16	16	0.899	0.993	0.089	0.544	0.055	0.054	0.899	0.993	0.090
		0.24	24	0.876	0.992	0.034	0.544	0.033	0.023	0.876	0.992	0.035
		0.32	32	0.854	0.984	0.020	0.544	0.036	0.016	0.854	0.984	0.023
		0.40	40	0.783	0.847	0.016	0.516	0.000	0.013	0.783	0.847	0.018
	200	0.04	8	0.958	1.000	0.892	0.433	0.120	0.110	0.958	1.000	0.892
		0.08	16	0.954	1.000	0.227	0.389	0.041	0.022	0.954	1.000	0.227
		0.16	32	0.938	1.000	0.006	0.369	0.014	0.001	0.938	1.000	0.008
		0.24	48	0.908	1.000	0.002	0.363	0.004	0.000	0.908	1.000	0.005
		0.32	64	0.874	1.000	0.001	0.357	0.002	0.000	0.874	1.000	0.003
		0.40	80	0.787	0.973	0.000	0.320	0.000	0.000	0.787	0.973	0.004
	500	0.04	20	0.992	1.000	0.891	0.176	0.014	0.002	0.992	1.000	0.891
		0.08	40	0.990	1.000	0.121	0.132	0.001	0.000	0.990	1.000	0.124
		0.16	80	0.979	1.000	0.005	0.119	0.001	0.000	0.979	1.000	0.007
		0.24	120	0.956	1.000	0.001	0.101	0.000	0.000	0.956	1.000	0.004
		0.32	160	0.912	1.000	0.000	0.108	0.000	0.000	0.912	1.000	0.004
		0.40	200	0.887	0.990	0.002	0.105	0.000	0.000	0.887	0.990	0.002
	1000	0.04	40	1.000	1.000	0.893	0.029	0.002	0.000	1.000	1.000	0.894
		0.08	80	0.998	1.000	0.086	0.024	0.003	0.000	0.998	1.000	0.087
		0.16	160	0.997	1.000	0.006	0.018	0.000	0.000	0.997	1.000	0.007
		0.24	240	0.983	1.000	0.002	0.008	0.000	0.000	0.983	1.000	0.003
		0.32	320	0.950	1.000	0.002	0.008	0.000	0.000	0.950	1.000	0.004
		0.40	400	0.909	0.999	0.001	0.013	0.000	0.000	0.909	0.999	0.005